

**Requerimientos de capital por las exposiciones frente a BME CLEARING a raíz de las contribuciones a la garantía colectiva de acuerdo a la metodología /  
Capital requirements for default fund exposures to BME CLEARING  
"Standardized Approach for Counterparty Credit Risk (SA-CCR)"**

29/12/2023

Resumen de estadísticas clave / Key Summary Statistics	Derivados Financieros / Financial Derivatives	Energía / Energy	Repo / Fixed Income	IRS	Renta Variable / Cash Equities
Unidad / Unit	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000	Eur 1000
N: Número de miembros compensadores / Number of clearing members	30	7	25	8	22
SIG: Recursos propios específicos de la ECC aportados previamente / CCP's Dedicated Own Resources	2.200	500	400	50	1.250
SSIG: Recursos propios específicos adicionales de la ECC aportados previamente / CCP's Additional Dedicated Own Resources	1.350	300	250	50	750
DF <sub>CCP</sub> = SIG+SSIG: Recursos propios totales de la ECC aportados previamente / CCP's total prefunded own resources	3.550	800	650	100	2.000
DF <sub>CM</sub> : Contribuciones a la garantía colectiva desembolsadas por todos los miembros compensadores / Prefunded default fund from all clearing members	369.950	78.200	66.950	5.050	212.050
<b>K<sub>CCP</sub>: Requerimiento de capital hipotético a la ECC / CCP hypothetical capital requirement</b>	4.513	309	0	4	0
C-factor = max( K <sub>CCP</sub> * ( DF <sub>i</sub> / (DF <sub>CCP</sub> + DF <sub>CM</sub> )); 8% * 2% * DF <sub>i</sub> )	<b>1,208%</b>	<b>0,391%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>	<b>0,160%</b>
KCMi if DF <sub>i</sub> = 1.000	12,08	3,91	1,60	1,60	1,60
Información adicional / Additional information					
Garantías Requeridas / Margins Required (IM*)	1.588.484	266.247	327.092	9.474	257.969

\*IM : Garantías por posición y garantías individuales / Initial Margin and Individual Funds